

友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金2009年第三季度报告

2009年09月30日

基金管理人：友邦华泰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2009年10月27日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2009年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2009年7月1日起至2009年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	友邦华泰盛世中国股票
交易代码	460001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年04月27日
报告期末基金份额总额	14,191,126,061.66
投资目标	主要通过股票选择，辅以适度的大类资产配置调整，追求管理资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以股票类资产为主要投资工具，通过精选个股获取资产的长期增值；以债券类资产作为降低组合风险的策略性投资工具，通过适当的大类资产配置来降低组合的系统性风险。
业绩比较基准	中信标普300指数×70%+中信国债指数×30%
风险收益特征	较高风险、较高收益
基金管理人	友邦华泰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2009年07月01日-2009年09月30日）
1. 本期已实现收益	473,755,148.86
2. 本期利润	-1,033,976,323.66

3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0737
4. 期末基金资产净值	7,999,742,308.83
5. 期末基金份额净值	0.5637

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-11.28%	2.40%	-2.89%	1.68%	-8.39%	0.72%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：图示日期为2005年4月27日至2009年9月30日。

1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十三条（二）投资范围、（八）投资组合中规定的各项比例，投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%，债券投资为基金净资产的0%-40%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁丰	本基金的基金经理、投资部总监	2007年07月26日	—	15年	梁丰先生，经济学硕士。历任中信集团中大投资管理有限公司证券投资部总经理、总经理助理、中信基金股权投资部总监、2004年3月至2006年1月任中信经典配置基金的基金经理，2005年11月至2007年4月任中信红利精选股票基金的基金经理。2007年4月加入友邦华泰基金管理有限公司，2007年7月起任投资部总监、友邦华泰盛世中国股票型基金基金经理。
郭楷泽	本基金的基金经理	2008年09月03日	—	12年	郭楷泽先生，复旦大学工商管理硕士。历任中信集团深圳中大投资管理有限公司研究员、投资经理，中信基金管理有限公司研究员、基金经理、投委会成员。2005年9月至2007年3月任中信经典配置基金投资经理，2007年4月至2008年5月任中信红利精选基金的基金经理。2008年6月，加入友邦华泰基金管理有限公司。2008年9月起任友邦华泰盛世中国股票型基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次集中交易室对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格均不相同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

(1) 行情回顾及运作分析

2009年3季度，初期在天量信贷利好推动下，市场持续上涨，而8月份在信贷“动态微调”下，金融、地产和周期性行业出现深幅下跌，9月则出现小幅反弹。报告期内中信标普300指数下跌4.79%，中标国债指数上涨0.34%。

三季度以来，汽车、医药、家电等行业涨幅较大，而铁路运输、地产、证券、银行等行业跌幅较大。本基金对由于信贷调整预期造成的下跌准备不足，在金融和周期性行业上配置较多，以至于表现差于基准。

(2) 本基金业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为0.5637元，本报告期份额净值增长率为-11.28%，同期业绩比较基准增长率为-2.89%。

(3) 市场展望和投资策略

截至2009年10月11日，中证500PE54.5倍，PB3.3倍；全部A股除金融PE36.6倍，PB3.5倍；沪深300PE21.9倍，PB3.14倍。与上一报告期相比，由于上市公司业绩增长和指数的下跌，估值水平有所降低。

三季度期间的经济数据表明，国内经济依旧在复苏的轨道中前进。国内消费保持了较快增长，尽管投资未来可能会有所下降，但美欧的经济也出现了向好的迹象，出口有望接替投资拉动经济增长。对于信贷总量的下降，市场已有较充分的预期，并对此做出了反应，而资金的机会成本依旧在相当低的水平，以市盈率倒数衡量的股市回报率处于合理水平。

因此，我们认为，市场结构性的机会依然存在，基金管理人将尽力发现投资机会，规避投资风险，为您的信任奉献回报。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,629,902,523.12	70.07
	其中：股票	5,629,902,523.12	70.07
2	固定收益投资	468,101,351.00	5.83
	其中：债券	468,101,351.00	5.83
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—

4	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	1,918,667,828.42	23.88
6	其他资产	17,581,063.05	0.22
7	合计	8,034,252,765.59	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	8,920,000.00	0.11
B	采掘业	1,270,790,640.67	15.89
C	制造业	1,674,437,316.24	20.93
C0	食品、饮料	261,865,767.01	3.27
C1	纺织、服装、皮毛	12,774,900.00	0.16
C2	木材、家具	25,185,200.00	0.31
C3	造纸、印刷	90,062,211.76	1.13
C4	石油、化学、塑胶、塑料	265,557,659.94	3.32
C5	电子	16,132,444.00	0.20
C6	金属、非金属	426,005,074.19	5.33
C7	机械、设备、仪表	486,089,263.39	6.08
C8	医药、生物制品	64,316,295.95	0.80
C99	其他制造业	26,448,500.00	0.33
D	电力、煤气及水的生产和供应业	147,288,947.82	1.84
E	建筑业	100,581,416.65	1.26
F	交通运输、仓储业	130,262,314.24	1.63
G	信息技术业	104,059,236.69	1.30
H	批发和零售贸易	135,170,920.03	1.69
I	金融、保险业	1,714,962,341.52	21.44
J	房地产业	290,939,102.71	3.64
K	社会服务业	3,034,644.87	0.04
L	传播与文化产业	42,975,641.68	0.54
M	综合类	6,480,000.00	0.08
	合计	5,629,902,523.12	70.38

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净
----	------	------	-------	---------	--------

					值比例（%）
1	601318	中国平安	9,849,832	499,386,482.40	6.24
2	000983	西山煤电	8,384,132	262,507,172.92	3.28
3	601699	潞安环能	6,540,816	245,673,048.96	3.07
4	601328	交通银行	29,296,366	244,038,728.78	3.05
5	000937	金牛能源	6,509,710	195,161,105.80	2.44
6	600000	浦发银行	9,775,828	192,095,020.20	2.40
7	601166	兴业银行	5,142,906	173,778,793.74	2.17
8	601169	北京银行	8,695,668	149,826,359.64	1.87
9	601601	中国太保	6,299,932	140,299,485.64	1.75
10	600001	邯郸钢铁	28,249,908	130,232,075.88	1.63

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	390,906,000.00	4.89
	其中：政策性金融债	390,906,000.00	4.89
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	可转债	77,195,351.00	0.96
7	其他	—	—
8	合计	468,101,351.00	5.85

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	080313	08进出13	2,100,000	210,084,000.00	2.63
2	080404	08农发04	1,500,000	150,540,000.00	1.88
3	110598	大荒转债	495,590	72,043,918.30	0.90
4	070222	07国开22	300,000	30,282,000.00	0.38
5	110007	博汇转债	46,330	5,151,432.70	0.06

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

5.8.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	7,376,349.62
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	3,592,952.05
4	应收利息	4,672,293.02
5	应收申购款	1,939,468.36
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	17,581,063.05

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110598	大荒转债	72,043,918.30	0.90

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	13,877,475,062.33
报告期期间基金总申购份额	1,551,877,541.78
报告期期间基金总赎回份额	1,238,226,542.45
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
报告期期末基金份额总额	14,191,126,061.66

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金募集的文件
- 2、《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金招募说明书》
- 4、《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金的公告

7.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人友邦华泰基金管理有限公司。

客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638

公司网址：www.aig-huatai.com